

<<金融工程>>

图书基本信息

书名：<<金融工程>>

13位ISBN编号：9787040353839

10位ISBN编号：7040353830

出版时间：2012-6

出版时间：高等教育出版社

作者：郑振龙，陈蓉 编

页数：337

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

内容概要

《金融工程（第3版）》先后入选“十五”、“十一五”国家级规划教材，2011年被教育评为普通高等教育精品教材。

本书根据读者的反馈在第二版的基础上进行了全面的修订。

本书延续了前两版数学模型与金融学紧密融合的突出特点，保留了前两版的清晰写作脉络、知识点的前后一致性和呼应性、丰富的教学内容和大量的教学辅助资料，进一步强化深入浅出的讲解风格，让读者能够获得对金融工程、金融衍生产品和风险管理问题的感性认识，引导读者更好地将理论和知识运用到实践中去。

书籍目录

第一章 金融工程概述第一节 什么是金融工程第二节 金融工程的发展历史与背景第三节 金融工程的基本分析方法本章小结习题第二章 远期与期货概述第一节 远期与远期市场第二节 期货与期货市场第三节 远期与期货的比较本章小结习题第三章 远期与期货定价第一节 远期价格与期货价格第二节 无收益资产远期合约的定价第三节 支付已知现金收益资产远期合约的定价第四节 支付已知收益率资产远期合约的定价第五节 远期与期货价格的一般结论第六节 远期(期货)价格与标的资产现货价格的关系本章小结习题第四章 远期与期货的运用第一节 运用远期与期货进行套期保值第二节 运用远期与期货进行套利与投机本章小结习题第五章 股指期货、外汇远期、利率远期与利率期货第一节 股票指数期货第二节 外汇远期第三节 远期利率协议第四节 利率期货本章小结习题第六章 互换概述第一节 互换的定义与种类第二节 互换市场本章小结习题第七章 互换的定价与风险分析第一节 利率互换的定价第二节 货币互换的定价第三节 互换的风险本章小结习题第八章 互换的运用第一节 运用互换进行套利第二节 运用互换进行风险管理第三节 运用互换构造新产品本章小结习题第九章 期权与期权市场第一节 期权的定义与种类第二节 期权市场第三节 期权交易机制第四节 期权与其他衍生产品的区别与联系本章小结习题第十章 期权的回报与价格分析第一节 期权的回报与盈亏分布第二节 期权价格的特性本章小结习题附录内在价值与平价点第十一章 布莱克-舒尔斯-默顿期权定价模型第一节 布莱克-舒尔斯-默顿期权定价模型的基本思想第二节 股票价格的变化过程第三节 布莱克-舒尔斯-默顿期权定价公式第四节 $B\&M$ 期权定价公式的精确度评价与拓展本章小结习题附录布莱克-舒尔斯-默顿期权定价公式的推导第十二章 期权定价的数值方法第一节 二叉树期权定价模型第二节 蒙特卡罗模拟第三节 有限差分方法本章小结习题第十三章 期权的交易策略及其运用第一节 期权交易头寸及其运用第二节 期权交易策略及其运用第三节 期权组合盈亏图的算法本章小结习题第十四章 期权价格的敏感性和期权的套期保值第一节 Δ 与期权的套期保值第二节 θ 与套期保值第三节 Γ 与套期保值第四节 $Vega$ 、 ρ 与套期保值第五节 交易费用与套期保值本章小结习题第十五章 股票指数期权、外汇期权、期货期权与利率期权第一节 欧式股票指数期权、外汇期权和期货期的定价第二节 标的资产支付连续红利的期权价格的敏感性第三节 利率期权本章小结习题第十六章 奇异期权第一节 常见的奇异期权第二节 奇异期权的主要性质本章小结习题第十七章 风险管理第一节 风险与风险管理概述第二节 在险值第三节 信用风险管理本章小结习题参考文献

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>